

中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65

§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 盈利投资者数量占比	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	68
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投量化进取	
基金主代码	011410	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 03 月 09 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	153,691,542.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C
下属分级基金的交易代码	011410	011411
报告期末下属分级基金的份 额总额	119,336,868.74 份	34,354,674.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对各类宏观经济指标及资产市场行为数据进行量化分析，判断当前市场行为热点、运动趋势以及投资者风险偏好，并构建多种估值、发展预期等因子指标。基于各因子与股票、债券等大类资产价格的内在相关性及其影响机制，分别进行定量判断、筛选及归类。在上述归类结果的基础上，灵活运用各类数量模型，分别构建股票、债券、货币等大类资产配置价值的趋势判断的量化因子，形成对股票、债券、货币等大类资产的配置观点。 本基金借鉴国内外成熟的组合投资策略，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，并根据市场状况及变化，定期对模型进行回溯和调整，提高模型有效性，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-56950806	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-65289868	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		金强	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C
本期已实现收益	24,052,367.90	6,866,809.75
本期利润	28,454,597.32	8,303,285.83
加权平均基金份额本期利润	0.1935	0.1916
本期加权平均净值利润率	16.12%	16.29%
本期基金份额净值增长率	16.91%	16.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	34,399,159.22	8,980,595.59
期末可供分配基金份额利润	0.2883	0.2614
期末基金资产净值	155,529,501.86	43,832,560.47
期末基金份额净值	1.3033	1.2759
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

基金份额累计净值增长率	30.33%	27.59%
-------------	--------	--------

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投量化进取 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.33%	1.37%	15.02%	1.32%	1.31%	0.05%
过去六个月	16.91%	1.34%	17.22%	1.33%	-0.31%	0.01%
过去一年	38.80%	1.14%	41.31%	1.14%	-2.51%	0.00%
过去三年	40.68%	1.15%	44.07%	1.18%	-3.39%	-0.03%
过去五年	22.13%	1.16%	33.23%	1.09%	-11.10%	0.07%
自基金合同生效起至今	30.33%	1.13%	43.08%	1.07%	-12.75%	0.06%

中信建投量化进取 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.21%	1.37%	15.02%	1.32%	1.19%	0.05%
过去六个月	16.68%	1.34%	17.22%	1.33%	-0.54%	0.01%
过去一年	38.25%	1.14%	41.31%	1.14%	-3.06%	0.00%
过去三年	39.00%	1.15%	44.07%	1.18%	-5.07%	-0.03%
过去五年	19.71%	1.16%	33.23%	1.09%	-13.52%	0.07%
自基金合同生效起至今	27.59%	1.13%	43.08%	1.07%	-15.49%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信建投量化进取A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年03月09日-2026年06月30日)



中信建投量化进取C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年03月09日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金管理、私募资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 71 只。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨志武	本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人、兼任指数与量化投资部行政负责人	2026-02-12	-	14 年	中国籍，伯明翰大学货币银行与金融学硕士。曾任职于北京首创期货有限责任公司期权及场外衍生品部从事衍生品投资与研究，中国国际期货股份有限公司金融业务部从事衍生品投资与研究，中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部从事证券投资研究、权益投资部担任投资经理。2022 年 3 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部行政负责人，兼任指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金、中信建投双和债券型证券投资基金基金经理。

艾翀	本基金的基金经理	2026-02-12	-	9 年	中国籍，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师，国金基金管理有限公司指数投资部、量化投资三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金销售有限公司基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿保险有限公司投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。
王鹏	本基金的基金经理	2021-03-09	2026-02-12	11 年	中国籍，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019 年 2 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金、中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金、中信建投沪深 300 指数增强型证券投资

					资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型证券投资基金、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金运作整体合法合规。本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、其他有关法律法规及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济整体保持稳健运行，但内部结构分化明显。从总量看，一季度 GDP 同比增长 5.4%，二季度增速虽有所回落但仍处于适度水平；从结构看，生产端强于需求端，外需强于内需，高技术产业强于传统产业。外贸是最大亮点，二季度进出口同比增长 18.4%，为 2021 年三季度以来最高增速，AI 硬件与新能源车出海为核心拉动。与之相对，内需仍受房地产开发投资持续拖累，居民与企业信用分化进一步显性化。价格指数方面，PPI 同比转正后持续上行，二季度已达 4.1%，而 CPI 温和运行在 1.0%附近，剪刀差扩大反映输入型涨价向下游传导不畅。从国际环境看，美国经济增长动力减弱，通胀粘性超出市场预期。美联储 1 月、3 月连续两次维持利率不变，6 月议息会议连续第四次按兵不动，联邦基金利率目标区间维持在 3.50%-3.75%，点阵图显示 18 名官员中 9 人预

计 2026 年内至少加息一次，2026 年底利率中值由 3.4% 上修至 3.8%，PCE 预期由 2.7% 大幅上调至 3.6%，紧缩预期再度升温。地缘政治方面，中东军事冲突在 3 月骤然升级一度推高油价，4 月美伊签署谅解备忘录后油价回落，但全球滞胀风险与流动性收紧预期贯穿上半年。

回顾上半年 A 股市场，整体呈现极致分化的结构性行情，宽基指数涨幅温和，而创业板指、科创综指等表现抢眼。行业层面分化极为显著：电子、通信等科技成长板块受到资金追捧涨幅居前，而商贸零售、农林牧渔、美容护理等传统行业持续调整。个股层面，翻倍股主要集中在半导体、电子化学品、光学光电子等与人工智能密切相关的细分领域。

在选股模型方面，本基金持续运行多因子选股体系，因子主要涵盖盈利质量、成长能力、估值水平以及量价行为等维度。报告期内，管理人结合市场环境变化对部分因子结构进行了适度优化，并加强了对因子稳定性与拥挤度的监测，以提升模型在不同市场环境下的适应能力。

在组合构建方面，本基金通过量化优化方法进行系统化配置，在控制行业偏离、风格暴露及个股权重的前提下，力求提升组合的风险收益比。同时通过适度分散持仓以降低个股波动对组合的影响。

在风险管理方面，本基金持续监控组合行业与风格暴露，动态调整风险预算，在市场波动阶段加强组合回撤控制，整体保持了相对稳健的运行状态。

未来管理人将继续优化模型与组合管理体系，以提升策略的稳定性与持续获取超额收益的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投量化进取 A 基金份额净值为 1.3033 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 16.91%，同期业绩比较基准收益率为 17.22%；截至报告期末中信建投量化进取 C 基金份额净值为 1.2759 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 16.68%，同期业绩比较基准收益率为 17.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年三季度，我们认为 A 股有望延续震荡上行态势，结构性机会依然丰富，但市场关注的焦点将从“讲故事”逐步转向“看业绩”。结合上半年运作的经验与当前宏观环境的变化，我们对下一阶段的投资判断如下：宏观与流动性层面，海外滞胀矛盾切换，国内政策效能持续释放。海外方面，地缘与美联储路径仍是主要扰动。美联储 6 月点阵图显示加息预期升温，但若美国“滞胀”矛盾逐步从“胀”切向“滞”，紧缩预期存在回摆空间。我们认为，伴随俄乌、美伊等地缘事件的风险外溢，全球能源安全可能会导致通胀压力上升，从而中断美联储的降息进程，但新兴市场估值修复的方向并未逆转。国内方面，超长期特别国债（1.3 万亿）与“反内卷”政策累积效应有望推动企业盈利预期从分化走向收敛，房地产等领域的结构性问题仍将制约反弹高度。产业趋势层面：AI 主线深化，从硬件基础设施向商业应用端延伸。产业趋势依然清晰，以 AI 为代表的科技创新正从硬件基础设施向商业应用端深化，半导体、算力等产业链业绩确定性较高，继续为经济增长提供核心动力。但需要警惕的是，与 2025 年不同，资本市场对于 AI 企业高资本开支的关注会提升，同时也会更加关注企业收入的兑现可能；另一方面，存在被人工智能发展所替代可能性的行业或公司，面临着估值下调的风险。“十五五”规划方向或将成为市场焦点，人工智能、高端制造、新能源、

自主可控等方向值得重点关注。此外，在“反内卷”政策以及经济回暖预期下，钢铁、有色金属等顺周期行业可能持续受益。

投资策略层面：组合层面再平衡估值与质量因子。相比二季度，我们会更聚焦风格与因子均值修复的情况，重新增加估值类因子、质量类因子的权重，风格与因子权重不做大开大合调整。在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，我们将充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争在行业与风格均衡配置的基础上，追求组合长期相对稳健的回报。与此同时，我们也将密切关注以下风险因素：一是海外经济下行超预期可能引发外部需求大幅收缩；二是地缘政治风险出现反复，对全球供应链造成冲击；三是美联储政策若超预期转向紧缩，可能引发全球资产价格剧烈调整；四是国内经济修复不及预期，特别是内需和地产恢复力度低于预期；五是科技板块估值与业绩兑现之间的错配可能引发结构性回调。总体而言，我们对中长期保持乐观态度。中国经济正在经历深刻的转型升级期，科技创新驱动增长的新动能正在积聚，权益市场的长期配置价值依然突出。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金
报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,959,330.17	17,113,715.18
结算备付金		4,463,636.43	10,743,208.41
存出保证金		2,142,768.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	153,580,238.04	242,665,535.67
其中：股票投资		153,537,307.21	242,643,090.86
基金投资		-	-
债券投资		42,930.83	22,444.81
资产支持证券		-	-
投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	29,000,000.00	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,553.85	5,367.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		201,151,526.49	270,527,827.04
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,449,410.68	1,324,136.13
应付管理人报酬		193,884.36	277,013.45
应付托管费		32,314.06	46,168.92
应付销售服务费		14,195.80	21,759.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,195.42	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	94,463.84	18,000.00
负债合计		1,789,464.16	1,687,078.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	153,691,542.81	242,279,219.20
未分配利润	6.4.7.8	45,670,519.52	26,561,529.74
净资产合计		199,362,062.33	268,840,748.94
负债和净资产总计		201,151,526.49	270,527,827.04

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 153,691,542.81 份，其中中信建投量化进取 A 类基金份额净值 1.3033 元，基金份额 119,336,868.74 份；中信建投量化进取 C 类基金份额净值 1.2759 元，基金份额 34,354,674.07 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		38,519,922.04	31,405,557.44
1. 利息收入		86,024.75	226,910.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,075.43	226,910.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		949.32	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,595,191.79	15,571,227.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,352,297.55	11,379,818.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	46,140.27	27,879.59
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	1,150,035.54	-
股利收益	6.4.7.13	1,046,718.43	4,163,529.29
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	5,838,705.50	15,607,419.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		1,762,038.89	3,408,460.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,358,336.52	2,691,033.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	226,389.40	448,505.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	101,552.92	188,260.45
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		4,300.66	0.07
8. 其他费用	6.4.7.17	71,459.39	80,660.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,757,883.15	27,997,096.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,757,883.15	27,997,096.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,757,883.15	27,997,096.98

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	242,279,219.20	26,561,529.74	268,840,748.94
二、本期期初净资产	242,279,219.20	26,561,529.74	268,840,748.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-88,587,676.39	19,108,989.78	-69,478,686.61
(一)、综合收益总额	-	36,757,883.15	36,757,883.15
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-88,587,676.39	-17,648,893.37	-106,236,569.76
其中：1. 基金申购款	2,171,580.91	420,010.81	2,591,591.72
2. 基金赎回款	-90,759,257.30	-18,068,904.18	-108,828,161.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	153,691,542.81	45,670,519.52	199,362,062.33
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	542,972,304.74	-65,999,389.82	476,972,914.92
二、本期期初净资产	542,972,304.74	-65,999,389.82	476,972,914.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-72,124,479.35	35,749,297.85	-36,375,181.50
(一)、综合收益总额	-	27,997,096.98	27,997,096.98
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-72,124,479.35	7,752,200.87	-64,372,278.48
其中：1. 基金申购款	839,136.78	-98,649.97	740,486.81
2. 基金赎回款	-72,963,616.13	7,850,850.84	-65,112,765.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	470,847,825.39	-30,250,091.97	440,597,733.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

金强

张欣宇

谭保民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2021)127 号《关于准予中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的运作方式为契约型开放式、最短持有期为 6 个月的单笔锁定持续运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,300,908,856.52 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0262 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,301,115,484.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 206,628.45 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不收取销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占基金资产的 60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 80%+中证综合债指数收益率 $\times$ 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金

融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	989,514.02
等于：本金	989,409.53
加：应计利息	104.49
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	10,969,816.15
等于：本金	10,966,631.57
加：应计利息	3,184.58

减：坏账准备	-
合计	11,959,330.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		145,070,582.57	-	153,537,307.21	8,466,724.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	16,000.00	2.67	42,930.83	26,928.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,000.00	2.67	42,930.83	26,928.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		145,086,582.57	2.67	153,580,238.04	8,493,652.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	17,480,520.00	-	-	-
一股指期货	17,480,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,480,520.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2607	中证 500 股指期货 2607 合约	10	17,856,400.00	375,880.00
合计				375,880.00
减：可抵销期货暂收款				375,880.00

净额				0.00
----	--	--	--	------

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	29,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	29,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,434.29
其他应付	8,029.55
合计	94,463.84

6.4.7.7 实收基金

中信建投量化进取 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	183,953,996.43	183,953,996.43
本期申购	1,768,677.22	1,768,677.22
本期赎回（以“-”号填列）	-66,385,804.91	-66,385,804.91
本期末	119,336,868.74	119,336,868.74

中信建投量化进取 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,325,222.77	58,325,222.77
本期申购	402,903.69	402,903.69
本期赎回（以“-”号填列）	-24,373,452.39	-24,373,452.39
本期末	34,354,674.07	34,354,674.07

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

中信建投量化进取 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,647,414.86	-2,538,399.49	21,109,015.37
本期期初	23,647,414.86	-2,538,399.49	21,109,015.37
本期利润	24,052,367.90	4,402,229.42	28,454,597.32
本期基金份额交易产生的变动数	-13,300,623.54	-70,356.03	-13,370,979.57
其中：基金申购款	368,405.51	-28,415.78	339,989.73
基金赎回款	-13,669,029.05	-41,940.25	-13,710,969.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,399,159.22	1,793,473.90	36,192,633.12

中信建投量化进取 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,253,949.31	-801,434.94	5,452,514.37
本期期初	6,253,949.31	-801,434.94	5,452,514.37
本期利润	6,866,809.75	1,436,476.08	8,303,285.83
本期基金份额交易产生的变动数	-4,140,163.47	-137,750.33	-4,277,913.80
其中：基金申购款	78,259.33	1,761.75	80,021.08
基金赎回款	-4,218,422.80	-139,512.08	-4,357,934.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,980,595.59	497,290.81	9,477,886.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,714.63
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	47,156.92
结算备付金利息收入	32,203.88
其他	—
合计	85,075.43

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,326,015,868.43
减：卖出股票成本总额	1,293,725,458.41
减：交易费用	1,938,112.47
买卖股票差价收入	30,352,297.55

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,021.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	34,119.08
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	46,140.27

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,228,953.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,057,811.00
减：应计利息总额	137,009.77
减：交易费用	13.84
买卖债券差价收入	34,119.08

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
期货投资	1,150,035.54

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,046,718.43
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,046,718.43

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,468,020.92
——股票投资	5,448,535.36
——债券投资	19,485.56
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	375,880.00
——权证投资	-
——期货投资	375,880.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	5,195.42
合计	5,838,705.50

6.4.7.15 其他收入

无。

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,025.10
合计	71,459.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	2,524,135,803.14	100.00%	3,526,778,959.10	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	10,092,964.69	100.00%	140,485.72	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	39,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,113,234.80	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,554,162.38	100.00%	-	-

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,358,336.52	2,691,033.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	669,271.49	1,327,937.69
应支付基金管理人的净管理费	689,065.03	1,363,095.97

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	226,389.40	448,505.60

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	436.64	436.64
中信建投证券股份有限公司	-	90,969.55	90,969.55
中信银行股份有限公司	-	1,397.88	1,397.88

中信建投期货有限公司	-	27.60	27.60
合计	-	92,831.67	92,831.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C	合计
中信银行股份有限公司	-	2,485.54	2,485.54
中信建投基金管理有限公司	-	600.09	600.09
中信建投期货有限公司	-	31.90	31.90
中信建投证券股份有限公司	-	174,260.51	174,260.51
合计	-	177,378.04	177,378.04

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	989,514.02	5,714.63	2,134,336.59	10,294.89
中信建投证券股份有限公司	10,969,816.15	47,156.92	28,678,088.20	53,097.84

注：本基金托管账户的存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信建投证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下配售	8,492	80,419.24
上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	850	8,049.50	59,619.00	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	352	6,927.36	49,804.48	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,167	20,445.84	41,918.64	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	83	3,698.48	38,899.61	-
688785	恒运	2026	6 个月	新股	92.18	463.15	75	6,913.50	34,736.25	-

	昌	年 01 月 20 日	月	流通 受限						
688635	长进 光子	2026 年 05 月 20 日	6 个 月	新股 流通 受限	40.98	308.19	104	4,261.92	32,051.76	-
001399	惠科 股份	2026 年 06 月 16 日	6 个 月	新股 流通 受限	10.12	27.73	1,110	11,233.20	30,780.30	-
001257	盛龙 股份	2026 年 03 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	7.82	20.74	1,025	8,015.50	21,258.50	-
688811	有研 复材	2026 年 04 月 01 日	6 个 月	新股 流通 受限	6.41	24.13	760	4,871.60	18,338.80	-
301687	新广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光 集团	2026 年 04 月 28 日	6 个 月	新股 流通 受限	13.30	51.56	283	3,763.90	14,591.48	-
603459	红板 科技	2026 年 03 月 31 日	6 个 月	新股 流通 受限	17.70	84.32	157	2,778.90	13,238.24	-
301696	三瑞 智能	2026 年 03 月 31 日	6 个 月	新股 流通 受限	24.68	86.80	151	3,726.68	13,106.80	-
301669	高特 电子	2026 年 06 月 02 日	6 个 月	新股 流通 受限	7.08	28.40	460	3,256.80	13,064.00	-
603407	长裕 集团	2026 年 04 月 29 日	6 个 月	新股 流通 受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301599	理奇	2026	6 个	新股	13.91	32.47	301	4,186.91	9,773.47	-

	智能	年 04 月 22 日	月	流通 受限						
301680	固德 电材	2026 年 02 月 27 日	6 个 月	新股 流通 受限	58.00	112.16	84	4,872.00	9,421.44	-
001365	天海 电子	2026 年 05 月 11 日	6 个 月	新股 流通 受限	27.19	31.31	255	6,933.45	7,984.05	-
301513	尚水 智能	2026 年 04 月 10 日	6 个 月	新股 流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
001393	维通 利	2026 年 05 月 08 日	6 个 月	新股 流通 受限	30.38	38.99	178	5,407.64	6,940.22	-
301683	慧谷 新材	2026 年 03 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	78.38	121.77	56	4,389.28	6,819.12	-
688816	易思 维	2026 年 02 月 04 日	6 个 月	新股 流通 受限	55.95	57.10	116	6,490.20	6,623.60	-
001237	惠康 科技	2026 年 05 月 15 日	6 个 月	新股 流通 受限	53.26	58.74	101	5,379.26	5,932.74	-
601112	振石 股份	2026 年 01 月 21 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.18	17.59	278	3,108.04	4,890.02	-
603435	嘉德 利	2026 年 05 月 15 日	6 个 月	新股 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信 股份	2026 年 01 月 08 日	6 个 月	新股 流通 受限	21.88	25.52	102	2,231.76	2,603.04	-
603284	林平	2026	6 个	新股	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

	发展	年 02 月 03 日	月	流通 受限						
001220	世盟 股份	2026 年 01 月 27 日	6 个 月	新股 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001312	福恩 股份	2026 年 04 月 14 日	6 个 月	新股 流通 受限	18.38	16.78	89	1,635.82	1,493.42	-
603293	埃泰 克	2026 年 04 月 09 日	6 个 月	新股 流通 受限	33.49	33.93	44	1,473.56	1,492.92	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停牌 日期	停 牌 原 因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
688072	拓荆 科技	2026- 06-29	重大 事项	832.00	2026- 07-13	890.99	233	108,385.25	193,856.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	42,930.83	22,444.81
未评级	-	-
合计	42,930.83	22,444.81

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,959,330.17	-	-	-	11,959,330.17
结算备付金	4,463,636.43	-	-	-	4,463,636.43
存出保证金	-	-	-	2,142,768.00	2,142,768.00
交易性金融资产	-	-	42,930.83	153,537,307.21	153,580,238.04
买入返售金融资产	29,000,000.00	-	-	-	29,000,000.00
应收申购款	-	-	-	5,553.85	5,553.85
资产总计	45,422,966.60	-	42,930.83	155,685,629.06	201,151,526.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,449,410.68	1,449,410.68
应付管理人	-	-	-	193,884.36	193,884.36

报酬					
应付托管费	-	-	-	32,314.06	32,314.06
应付销售服务费	-	-	-	14,195.80	14,195.80
应交税费	-	-	-	5,195.42	5,195.42
其他负债	-	-	-	94,463.84	94,463.84
负债总计	-	-	-	1,789,464.16	1,789,464.16
利率敏感度缺口	45,422,966.60	-	42,930.83	153,896,164.90	199,362,062.33
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,113,715.18	-	-	-	17,113,715.18
结算备付金	10,743,208.41	-	-	-	10,743,208.41
交易性金融资产	-	-	22,444.81	242,643,090.86	242,665,535.67
应收申购款	-	-	-	5,367.78	5,367.78
资产总计	27,856,923.59	-	22,444.81	242,648,458.64	270,527,827.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,324,136.13	1,324,136.13
应付管理人报酬	-	-	-	277,013.45	277,013.45
应付托管费	-	-	-	46,168.92	46,168.92
应付销售服务费	-	-	-	21,759.60	21,759.60
其他负债	-	-	-	18,000.00	18,000.00
负债总计	-	-	-	1,687,078.10	1,687,078.10
利率敏感度缺口	27,856,923.59	-	22,444.81	240,961,380.54	268,840,748.94

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	153,537,307.21	77.01	242,643,090.86	90.26
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	42,930.83	0.02	22,444.81	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	153,580,238.04	77.04	242,665,535.67	90.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	9,681,876.72	13,646,130.23
	业绩比较基准下降 5%	-9,681,876.72	-13,646,130.23

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	152,900,691.22	241,193,778.49
第二层次	193,856.00	1,251,226.08
第三层次	485,690.82	220,531.10
合计	153,580,238.04	242,665,535.67

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	153,537,307.21	76.33
	其中：股票	153,537,307.21	76.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	42,930.83	0.02
	其中：债券	42,930.83	0.02
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	29,000,000.00	14.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	16,422,966.60	8.16
8	其他各项资产	2,148,321.85	1.07
9	合计	201,151,526.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	180,067.00	0.09
B	采矿业	5,526,964.50	2.77
C	制造业	118,759,222.13	59.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,028,183.00	0.52
E	建筑业	1,644,454.00	0.82
F	批发和零售业	3,855,601.80	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	1,293,111.46	0.65
H	住宿和餐饮业	205,086.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,117,230.54	5.58
J	金融业	3,565,991.00	1.79
K	房地产业	1,102,789.00	0.55
L	租赁和商务服务业	1,012,584.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	1,455,497.58	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,874,240.20	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	400,713.00	0.20
Q	卫生和社会工作	89,534.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	217,842.00	0.11
S	综合	208,196.00	0.10
	合计	153,537,307.21	77.01

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688002	睿创微纳	13,252	2,049,951.88	1.03
2	301217	铜冠铜箔	10,300	1,700,221.00	0.85
3	688519	南亚新材	4,400	1,672,176.00	0.84
4	688498	源杰科技	800	1,508,800.00	0.76
5	002008	大族激光	9,900	1,486,089.00	0.75
6	300604	长川科技	4,300	1,468,106.00	0.74
7	300308	中际旭创	1,100	1,397,000.00	0.70
8	688008	澜起科技	4,400	1,363,560.00	0.68
9	002281	光迅科技	5,300	1,361,782.00	0.68
10	300475	香农芯创	4,400	1,320,000.00	0.66
11	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.64
12	300857	协创数据	3,560	1,210,044.00	0.61
13	300054	鼎龙股份	11,400	1,208,058.00	0.61
14	688525	佰维存储	2,200	1,088,406.00	0.55
15	301377	鼎泰高科	1,900	1,046,710.00	0.53
16	000783	长江证券	101,500	989,625.00	0.50
17	603115	海星股份	7,900	967,513.00	0.49
18	600487	亨通光电	8,800	962,192.00	0.48
19	688256	寒武纪	600	957,330.00	0.48
20	605289	罗曼股份	6,600	957,000.00	0.48
21	600885	宏发股份	27,600	951,924.00	0.48
22	601233	桐昆股份	41,500	898,475.00	0.45
23	688127	蓝特光学	9,040	882,304.00	0.44
24	002821	凯莱英	5,400	874,800.00	0.44
25	688025	杰普特	1,800	846,000.00	0.42
26	600988	赤峰黄金	32,100	844,872.00	0.42
27	603950	长源东谷	9,800	827,414.00	0.42
28	688041	海光信息	2,200	814,660.00	0.41
29	300757	罗博特科	1,300	804,700.00	0.40
30	688257	新锐股份	7,880	802,972.00	0.40
31	002353	杰瑞股份	5,200	793,000.00	0.40
32	688301	奕瑞科技	6,356	788,144.00	0.40
33	688385	复旦微电	11,000	784,190.00	0.39
34	688099	晶晨股份	7,390	760,431.00	0.38
35	600141	兴发集团	15,500	728,035.00	0.37
36	002851	麦格米特	4,300	718,874.00	0.36

37	002126	银轮股份	14,200	707,160.00	0.35
38	000703	恒逸石化	51,700	701,569.00	0.35
39	688200	华峰测控	1,296	680,529.60	0.34
40	688521	芯原股份	1,800	668,052.00	0.34
41	688308	欧科亿	3,600	654,516.00	0.33
42	301358	湖南裕能	8,600	652,482.00	0.33
43	000657	中钨高新	6,700	641,324.00	0.32
44	002138	顺络电子	8,600	628,660.00	0.32
45	300567	精测电子	1,900	603,440.00	0.30
46	002273	水晶光电	16,900	599,612.00	0.30
47	600109	国金证券	68,100	597,918.00	0.30
48	688019	安集科技	1,760	597,449.60	0.30
49	300136	信维通信	4,800	572,400.00	0.29
50	002202	金风科技	23,200	554,480.00	0.28
51	300001	特锐德	14,100	533,403.00	0.27
52	688122	西部超导	8,400	527,604.00	0.26
53	688668	鼎通科技	1,400	522,620.00	0.26
54	600498	烽火通信	7,100	522,560.00	0.26
55	688059	华锐精密	2,600	519,246.00	0.26
56	601567	三星电气	34,400	513,936.00	0.26
57	600549	厦门钨业	6,000	511,200.00	0.26
58	688456	有研粉材	3,600	502,560.00	0.25
59	688578	艾力斯	4,600	502,320.00	0.25
60	002444	巨星科技	15,600	485,160.00	0.24
61	688676	金盘科技	5,700	482,448.00	0.24
62	603156	养元饮品	9,800	480,886.00	0.24
63	000933	神火股份	22,600	479,120.00	0.24
64	600176	中国巨石	6,500	473,720.00	0.24
65	300548	长芯博创	1,700	472,600.00	0.24
66	688188	柏楚电子	4,340	463,078.00	0.23
67	300684	中石科技	7,500	457,500.00	0.23
68	688018	乐鑫科技	3,576	457,441.92	0.23
69	002850	科达利	2,400	454,320.00	0.23
70	603317	天味食品	34,900	454,049.00	0.23
71	603061	金海通	900	451,998.00	0.23
72	300751	迈为股份	1,600	451,936.00	0.23
73	603256	宏和科技	1,700	451,061.00	0.23
74	002203	海亮股份	19,300	441,005.00	0.22
75	300496	中科创达	7,100	438,709.00	0.22
76	603067	振华股份	9,400	435,126.00	0.22
77	003031	中瓷电子	2,400	432,720.00	0.22
78	002056	横店东磁	14,100	429,768.00	0.22
79	002409	雅克科技	1,900	426,550.00	0.21

80	603806	福斯特	25,300	424,787.00	0.21
81	603530	神马电力	8,300	422,470.00	0.21
82	002182	宝武镁业	27,100	421,947.00	0.21
83	301093	华兰股份	3,100	420,453.00	0.21
84	300919	中伟新材	9,600	420,000.00	0.21
85	000951	中国重汽	21,500	419,465.00	0.21
86	000962	东方钽业	4,600	416,760.00	0.21
87	002025	航天电器	5,400	411,588.00	0.21
88	688568	中科星图	9,800	406,406.00	0.20
89	600563	法拉电子	2,100	400,680.00	0.20
90	000893	亚钾国际	9,700	396,633.00	0.20
91	002465	海格通信	31,000	395,870.00	0.20
92	688778	厦钨新能	7,225	393,040.00	0.20
93	600392	盛和资源	13,200	392,964.00	0.20
94	000960	锡业股份	9,200	392,748.00	0.20
95	000967	盈峰环境	37,200	391,716.00	0.20
96	002429	兆驰股份	37,700	391,703.00	0.20
97	601699	潞安环能	27,200	388,416.00	0.19
98	603588	高能环境	20,200	387,840.00	0.19
99	603663	三祥新材	4,000	385,200.00	0.19
100	300277	汽轮科技	25,600	385,024.00	0.19
101	601155	新城控股	37,500	384,750.00	0.19
102	603129	春风动力	1,500	383,700.00	0.19
103	688388	嘉元科技	8,630	379,720.00	0.19
104	002155	湖南黄金	15,800	377,146.00	0.19
105	300843	胜蓝股份	2,400	375,000.00	0.19
106	688390	固德威	3,400	368,934.00	0.19
107	002290	禾盛新材	4,000	367,480.00	0.18
108	603699	纽威股份	7,300	367,190.00	0.18
109	601168	西部矿业	13,300	360,962.00	0.18
110	002266	浙富控股	71,300	360,778.00	0.18
111	688179	阿拉丁	13,000	360,230.00	0.18
112	600985	淮北矿业	25,600	359,680.00	0.18
113	600710	苏美达	37,400	357,544.00	0.18
114	688136	科兴制药	17,200	356,212.00	0.18
115	603612	索通发展	19,500	353,535.00	0.18
116	002831	裕同科技	9,874	351,119.44	0.18
117	000039	中集集团	43,100	349,541.00	0.18
118	300814	中富电路	1,700	347,650.00	0.17
119	603688	石英股份	4,200	346,962.00	0.17
120	301345	涛涛车业	1,500	346,500.00	0.17
121	600312	平高电气	19,600	346,136.00	0.17
122	601615	明阳智能	29,700	343,629.00	0.17

123	603306	华懋科技	3,300	342,177.00	0.17
124	600497	驰宏锌锗	27,800	336,658.00	0.17
125	603290	斯达半导	2,200	336,468.00	0.17
126	603063	禾望电气	6,300	333,207.00	0.17
127	603308	应流股份	5,500	332,200.00	0.17
128	688110	东芯股份	1,600	325,920.00	0.16
129	600230	沧州大化	25,000	325,500.00	0.16
130	603979	金诚信	5,500	324,665.00	0.16
131	600961	株冶集团	10,000	323,900.00	0.16
132	603160	汇顶科技	5,200	320,892.00	0.16
133	688379	华光新材	3,800	319,314.00	0.16
134	603931	格林达	5,300	314,820.00	0.16
135	002649	博彦科技	38,600	314,204.00	0.16
136	002912	中新赛克	17,000	313,480.00	0.16
137	300492	华图山鼎	9,100	312,585.00	0.16
138	000534	万泽股份	11,400	311,904.00	0.16
139	002534	西子洁能	16,800	311,640.00	0.16
140	603031	安孚科技	5,835	310,713.75	0.16
141	000830	鲁西化工	25,800	309,600.00	0.16
142	002913	奥士康	4,800	306,912.00	0.15
143	688766	普冉股份	400	306,640.00	0.15
144	002064	华峰化学	32,300	306,527.00	0.15
145	001339	智微智能	2,990	305,817.20	0.15
146	300861	美畅股份	12,100	304,799.00	0.15
147	000932	华菱钢铁	87,800	304,666.00	0.15
148	603225	新凤鸣	15,500	304,575.00	0.15
149	000034	神州数码	10,960	304,140.00	0.15
150	600903	贵州燃气	45,700	303,448.00	0.15
151	002768	国恩股份	5,828	303,405.68	0.15
152	605016	百龙创园	11,700	302,445.00	0.15
153	301086	鸿富瀚	1,440	301,363.20	0.15
154	600299	安迪苏	38,300	300,655.00	0.15
155	300811	铂科新材	3,166	300,421.74	0.15
156	002683	广东宏大	10,100	295,829.00	0.15
157	688787	海天瑞声	2,200	295,790.00	0.15
158	605196	华通线缆	11,300	294,930.00	0.15
159	002969	嘉美包装	20,900	294,272.00	0.15
160	000878	云南铜业	18,500	293,780.00	0.15
161	603713	密尔克卫	4,100	291,797.00	0.15
162	300677	英科医疗	7,400	289,858.00	0.15
163	603920	世运电路	6,000	288,240.00	0.14
164	002294	信立泰	9,000	287,010.00	0.14
165	300938	信测标准	5,700	284,316.00	0.14

166	301338	凯格精机	1,740	283,428.60	0.14
167	688663	新风光	3,200	283,072.00	0.14
168	688690	纳微科技	6,400	282,240.00	0.14
169	601665	齐鲁银行	48,900	282,153.00	0.14
170	000801	四川九洲	21,800	282,092.00	0.14
171	002396	星网锐捷	14,660	281,032.20	0.14
172	002078	太阳纸业	22,500	281,025.00	0.14
173	600711	盛屯矿业	25,600	280,832.00	0.14
174	300689	澄天伟业	4,000	280,720.00	0.14
175	603659	璞泰来	9,700	280,621.00	0.14
176	688266	泽璟制药	2,400	279,984.00	0.14
177	000629	钒钛股份	83,300	278,222.00	0.14
178	605060	联德股份	4,900	278,026.00	0.14
179	603876	鼎胜新材	10,600	275,706.00	0.14
180	688187	时代电气	4,000	274,640.00	0.14
181	002244	滨江集团	35,700	271,320.00	0.14
182	002945	华林证券	20,200	271,286.00	0.14
183	688776	国光电气	4,400	269,896.00	0.14
184	300454	深信服	2,800	269,360.00	0.14
185	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.13
186	002478	常宝股份	42,600	263,268.00	0.13
187	688383	新益昌	1,400	263,256.00	0.13
188	603233	大参林	17,500	263,025.00	0.13
189	002080	中材科技	2,900	261,000.00	0.13
190	688258	卓易信息	2,200	260,788.00	0.13
191	600183	生益科技	1,500	260,100.00	0.13
192	688221	前沿生物	11,600	259,840.00	0.13
193	601020	华钰矿业	10,800	259,092.00	0.13
194	002947	恒铭达	3,400	258,570.00	0.13
195	688510	航亚科技	10,800	257,904.00	0.13
196	688408	中信博	8,000	257,200.00	0.13
197	601958	金钼股份	9,000	252,990.00	0.13
198	688621	阳光诺和	4,600	252,586.00	0.13
199	688196	卓越新能	7,000	251,300.00	0.13
200	002979	雷赛智能	4,500	251,010.00	0.13
201	300223	北京君正	1,000	248,900.00	0.12
202	605168	三人行	4,900	248,136.00	0.12
203	002935	天奥电子	11,300	247,922.00	0.12
204	300735	光弘科技	10,900	247,866.00	0.12
205	002616	长青集团	55,400	247,638.00	0.12
206	000426	兴业银锡	7,400	243,904.00	0.12
207	002986	宇新股份	20,600	243,698.00	0.12
208	688155	先惠技术	3,000	242,670.00	0.12

209	600909	华安证券	21,800	242,198.00	0.12
210	000032	深桑达 A	9,700	242,015.00	0.12
211	603345	安井食品	3,000	240,570.00	0.12
212	000683	博源化工	41,700	240,192.00	0.12
213	002539	云图控股	21,200	239,984.00	0.12
214	300285	国瓷材料	2,300	237,314.00	0.12
215	688108	赛诺医疗	12,800	237,184.00	0.12
216	603816	顾家家居	10,600	237,016.00	0.12
217	002928	华夏航空	33,900	236,961.00	0.12
218	002170	芭田股份	21,800	236,748.00	0.12
219	601666	平煤股份	33,100	236,665.00	0.12
220	688156	路德科技	7,800	235,950.00	0.12
221	002624	完美世界	18,900	234,738.00	0.12
222	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.12
223	688553	汇宇制药	22,000	233,860.00	0.12
224	688472	阿特斯	21,600	233,712.00	0.12
225	600208	衢州发展	81,800	231,494.00	0.12
226	002271	东方雨虹	19,500	231,465.00	0.12
227	002956	西麦食品	11,100	230,436.00	0.12
228	603766	隆鑫通用	19,300	230,249.00	0.12
229	600429	三元股份	56,900	229,876.00	0.12
230	002532	天山铝业	21,400	229,622.00	0.12
231	603298	杭叉集团	9,600	229,056.00	0.11
232	300681	英搏尔	8,000	228,960.00	0.11
233	002916	深南电路	500	228,950.00	0.11
234	300850	新强联	8,500	227,800.00	0.11
235	002886	沃特股份	8,100	227,529.00	0.11
236	301155	海力风电	5,300	227,370.00	0.11
237	002152	广电运通	24,200	226,996.00	0.11
238	688095	福昕软件	3,800	225,834.00	0.11
239	688220	翱捷科技	1,800	223,776.00	0.11
240	688001	华兴源创	2,600	222,820.00	0.11
241	300008	天海防务	36,700	222,402.00	0.11
242	600571	信雅达	22,800	222,300.00	0.11
243	002318	久立特材	9,300	222,270.00	0.11
244	688313	仕佳光子	1,200	221,580.00	0.11
245	300627	华测导航	7,800	221,520.00	0.11
246	603939	益丰药房	12,300	221,154.00	0.11
247	601179	中国西电	14,800	220,816.00	0.11
248	300699	光威复材	7,700	220,605.00	0.11
249	300793	佳禾智能	19,600	220,500.00	0.11
250	601231	环旭电子	6,800	220,320.00	0.11
251	002221	东华能源	41,800	219,868.00	0.11

252	300036	超图软件	19,400	218,638.00	0.11
253	601611	中国核建	19,600	218,540.00	0.11
254	688536	思瑞浦	600	218,454.00	0.11
255	688186	广大特材	14,400	218,160.00	0.11
256	000623	吉林敖东	12,300	218,079.00	0.11
257	605118	力鼎光电	6,200	216,318.00	0.11
258	002463	沪电股份	1,400	213,920.00	0.11
259	688123	聚辰股份	1,000	212,600.00	0.11
260	600826	兰生股份	24,100	211,839.00	0.11
261	300432	富临精工	10,400	208,936.00	0.10
262	600673	东阳光	6,200	208,196.00	0.10
263	688767	博拓生物	6,400	208,064.00	0.10
264	600754	锦江酒店	11,400	205,086.00	0.10
265	000738	航发控制	11,200	204,848.00	0.10
266	300450	先导智能	5,000	203,600.00	0.10
267	002345	潮宏基	22,200	203,574.00	0.10
268	601061	中信金属	18,800	202,476.00	0.10
269	603568	伟明环保	13,040	200,555.20	0.10
270	600346	恒力石化	11,300	200,123.00	0.10
271	688208	道通科技	7,800	196,482.00	0.10
272	688072	拓荆科技	233	193,856.00	0.10
273	688213	思特威	1,800	192,726.00	0.10
274	300855	图南股份	6,100	190,686.00	0.10
275	688375	国博电子	1,800	187,740.00	0.09
276	603833	欧派家居	6,200	186,682.00	0.09
277	600663	陆家嘴	29,600	185,888.00	0.09
278	688353	华盛锂电	1,600	185,712.00	0.09
279	688047	龙芯中科	1,200	185,604.00	0.09
280	688183	生益电子	1,400	185,360.00	0.09
281	688141	杰华特	1,200	184,200.00	0.09
282	002432	九安医疗	2,600	183,768.00	0.09
283	600295	鄂尔多斯	16,500	176,880.00	0.09
284	688037	芯源微	400	175,620.00	0.09
285	301371	敷尔佳	6,700	174,200.00	0.09
286	600967	内蒙一机	16,000	173,600.00	0.09
287	300972	万辰集团	1,000	173,410.00	0.09
288	600316	洪都航空	6,200	173,228.00	0.09
289	300476	胜宏科技	500	173,215.00	0.09
290	002028	思源电气	1,000	173,000.00	0.09
291	688052	纳芯微	600	172,986.00	0.09
292	300373	扬杰科技	1,100	172,953.00	0.09
293	600339	中油工程	55,800	171,306.00	0.09
294	002738	中矿资源	2,900	171,071.00	0.09

295	002837	英维克	2,140	170,258.40	0.09
296	601865	福莱特	16,100	169,211.00	0.08
297	300628	亿联网络	5,000	169,100.00	0.08
298	688582	芯动联科	2,600	169,000.00	0.08
299	688728	格科微	8,000	168,320.00	0.08
300	688608	恒玄科技	1,000	167,190.00	0.08
301	600251	冠农股份	19,200	165,888.00	0.08
302	002966	苏州银行	23,800	165,648.00	0.08
303	601577	长沙银行	19,000	165,490.00	0.08
304	688777	中控技术	1,400	164,500.00	0.08
305	301219	腾远钴业	3,000	164,400.00	0.08
306	600399	抚顺特钢	39,900	163,989.00	0.08
307	300602	飞荣达	3,200	163,840.00	0.08
308	600188	兖矿能源	9,200	163,484.00	0.08
309	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.08
310	002487	大金重工	2,800	162,316.00	0.08
311	600517	国网英大	33,200	155,376.00	0.08
312	600685	中船防务	6,100	155,184.00	0.08
313	300487	蓝晓科技	2,600	153,010.00	0.08
314	002595	豪迈科技	3,255	151,683.00	0.08
315	002558	巨人网络	5,500	151,580.00	0.08
316	600114	东睦股份	4,000	151,040.00	0.08
317	601899	紫金矿业	6,000	150,840.00	0.08
318	603969	银龙股份	20,500	149,035.00	0.07
319	603808	歌力思	19,600	148,372.00	0.07
320	300395	菲利华	1,100	147,103.00	0.07
321	605020	永和股份	3,600	146,592.00	0.07
322	688692	达梦数据	600	146,574.00	0.07
323	603179	新泉股份	2,920	144,978.00	0.07
324	603228	景旺电子	2,000	144,820.00	0.07
325	688709	成都华微	3,800	144,742.00	0.07
326	301128	强瑞技术	920	143,428.00	0.07
327	601609	金田股份	13,200	142,560.00	0.07
328	001389	广合科技	600	142,350.00	0.07
329	688486	龙迅股份	2,200	139,876.00	0.07
330	688433	华曙高科	1,600	136,960.00	0.07
331	001286	陕西能源	13,500	136,890.00	0.07
332	600764	中国海防	7,800	135,954.00	0.07
333	002545	东方铁塔	8,300	134,626.00	0.07
334	002544	普天科技	7,300	133,006.00	0.07
335	301529	福赛科技	1,380	132,976.80	0.07
336	300257	开山股份	4,600	131,928.00	0.07
337	688049	炬芯科技	2,800	131,348.00	0.07

338	300358	楚天科技	16,400	131,200.00	0.07
339	600021	上海电力	8,700	131,109.00	0.07
340	300207	欣旺达	6,900	131,031.00	0.07
341	301656	联合动力	7,600	130,948.00	0.07
342	603119	浙江荣泰	1,960	130,026.40	0.07
343	688153	唯捷创芯	4,000	128,480.00	0.06
344	002183	怡亚通	24,000	127,920.00	0.06
345	600482	中国动力	3,800	124,640.00	0.06
346	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.06
347	688615	合合信息	1,080	122,148.00	0.06
348	600875	东方电气	4,200	120,834.00	0.06
349	002475	立讯精密	1,700	119,680.00	0.06
350	603059	倍加洁	4,900	118,825.00	0.06
351	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.06
352	300750	宁德时代	300	117,903.00	0.06
353	300408	三环集团	700	116,830.00	0.06
354	600369	西南证券	28,700	115,374.00	0.06
355	300394	天孚通信	380	115,018.40	0.06
356	603338	浙江鼎力	2,700	114,750.00	0.06
357	600562	国睿科技	5,400	114,588.00	0.06
358	688607	康众医疗	2,200	112,200.00	0.06
359	002340	格林美	16,900	111,709.00	0.06
360	003022	联泓新科	4,300	111,370.00	0.06
361	688630	芯碁微装	200	109,878.00	0.06
362	600686	金龙汽车	9,700	109,513.00	0.05
363	688679	通源环境	2,600	109,434.00	0.05
364	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.05
365	600350	山东高速	9,800	109,074.00	0.05
366	300438	鹏辉能源	1,300	107,705.00	0.05
367	300650	太龙股份	7,400	107,522.00	0.05
368	300433	蓝思科技	2,000	107,320.00	0.05
369	603997	继峰股份	9,000	106,470.00	0.05
370	603730	岱美股份	9,500	106,115.00	0.05
371	688349	三一重能	6,980	105,956.40	0.05
372	002673	西部证券	16,300	105,787.00	0.05
373	603301	振德医疗	1,200	104,592.00	0.05
374	002157	正邦科技	37,000	103,970.00	0.05
375	688120	华海清科	320	103,097.60	0.05
376	600590	泰豪科技	10,200	103,020.00	0.05
377	600113	浙江东日	3,100	102,858.00	0.05
378	600309	万华化学	1,500	102,615.00	0.05
379	688235	百济神州	400	101,844.00	0.05
380	002074	国轩高科	3,700	101,787.00	0.05

381	002128	电投能源	4,400	101,728.00	0.05
382	688448	磁谷科技	1,600	101,696.00	0.05
383	300115	长盈精密	3,600	100,584.00	0.05
384	688623	双元科技	1,000	100,460.00	0.05
385	000831	中国稀土	1,800	99,882.00	0.05
386	301257	普蕊斯	2,200	99,836.00	0.05
387	300002	神州泰岳	12,700	99,187.00	0.05
388	301489	思泉新材	600	98,748.00	0.05
389	000155	川能动力	8,200	98,236.00	0.05
390	688082	盛美上海	224	96,768.00	0.05
391	002841	视源股份	2,800	96,684.00	0.05
392	600839	四川长虹	13,800	96,324.00	0.05
393	300819	聚杰微纤	1,300	96,226.00	0.05
394	688539	高华科技	3,000	95,640.00	0.05
395	002402	和而泰	3,700	95,571.00	0.05
396	605117	德业股份	900	95,562.00	0.05
397	002237	恒邦股份	6,500	95,485.00	0.05
398	002930	宏川智慧	10,300	94,760.00	0.05
399	300224	正海磁材	7,100	94,643.00	0.05
400	688230	芯导科技	1,200	94,572.00	0.05
401	600475	华光环能	6,200	94,550.00	0.05
402	002484	江海股份	900	94,500.00	0.05
403	688636	智明达	2,600	94,198.00	0.05
404	300101	振芯科技	5,800	93,786.00	0.05
405	300563	神宇股份	3,300	93,687.00	0.05
406	600801	华新建材	6,000	93,600.00	0.05
407	600095	湘财股份	12,400	93,372.00	0.05
408	000582	北部湾港	8,700	93,351.00	0.05
409	300963	中洲特材	6,900	92,667.00	0.05
410	000338	潍柴动力	3,400	92,650.00	0.05
411	300455	航天智装	4,300	92,622.00	0.05
412	688439	振华风光	2,000	92,400.00	0.05
413	001298	好上好	4,430	91,922.50	0.05
414	300724	捷佳伟创	1,300	91,780.00	0.05
415	301119	正强股份	3,740	91,779.60	0.05
416	301550	斯菱智驱	1,000	91,430.00	0.05
417	300984	金沃股份	1,700	91,341.00	0.05
418	603583	捷昌驱动	4,000	91,200.00	0.05
419	688479	友车科技	2,400	91,128.00	0.05
420	603200	上海洗霸	2,100	91,056.00	0.05
421	002156	通富微电	1,200	91,044.00	0.05
422	301280	珠城科技	1,800	91,026.00	0.05
423	300389	艾比森	7,100	91,022.00	0.05

424	688109	品茗科技	1,200	90,840.00	0.05
425	601136	首创证券	6,500	90,675.00	0.05
426	688281	华秦科技	1,800	90,414.00	0.05
427	688651	盛邦安全	2,800	90,216.00	0.05
428	301333	诺思格	1,800	90,162.00	0.05
429	603396	金辰股份	3,400	90,100.00	0.05
430	300183	东软载波	8,600	89,870.00	0.05
431	300337	银邦股份	7,700	89,782.00	0.05
432	601595	上海电影	5,400	89,640.00	0.04
433	002044	美年健康	17,800	89,534.00	0.04
434	300127	银河磁体	3,200	89,440.00	0.04
435	600390	五矿资本	19,600	89,376.00	0.04
436	600693	东百集团	11,400	89,376.00	0.04
437	605218	伟时电子	5,400	89,262.00	0.04
438	300413	芒果超媒	6,100	89,243.00	0.04
439	603737	三棵树	3,700	89,170.00	0.04
440	002791	坚朗五金	6,800	89,080.00	0.04
441	605599	菜百股份	6,500	89,050.00	0.04
442	002094	青岛金王	20,300	88,914.00	0.04
443	300509	新美星	10,600	88,828.00	0.04
444	600838	上海九百	12,400	88,660.00	0.04
445	002985	北摩高科	3,200	88,640.00	0.04
446	300339	润和软件	2,300	88,573.00	0.04
447	600066	宇通客车	3,300	88,473.00	0.04
448	002371	北方华创	100	88,456.00	0.04
449	603097	江苏华辰	3,300	88,407.00	0.04
450	300192	科德教育	5,400	88,128.00	0.04
451	000633	合金投资	18,500	88,060.00	0.04
452	603933	睿能科技	3,900	87,945.00	0.04
453	002045	国光电器	11,200	87,920.00	0.04
454	300941	创识科技	6,400	87,872.00	0.04
455	002029	七匹狼	11,500	87,860.00	0.04
456	301082	久盛电气	9,800	87,808.00	0.04
457	002320	海峡股份	14,000	87,780.00	0.04
458	301398	星源卓镁	2,500	87,775.00	0.04
459	002093	国脉科技	13,900	87,570.00	0.04
460	300445	康斯特	4,200	87,444.00	0.04
461	603696	安记食品	7,600	87,400.00	0.04
462	301159	三维天地	3,000	87,300.00	0.04
463	002899	英派斯	4,000	87,200.00	0.04
464	002606	大连电瓷	6,500	87,165.00	0.04
465	603596	伯特利	3,504	87,039.36	0.04
466	300805	电声股份	12,000	87,000.00	0.04

467	603300	海南华铁	19,100	86,905.00	0.04
468	002324	普利特	7,200	86,904.00	0.04
469	600865	百大集团	10,600	86,814.00	0.04
470	301052	果麦文化	3,900	86,658.00	0.04
471	300378	鼎捷数智	2,400	86,640.00	0.04
472	300662	科锐国际	5,100	86,598.00	0.04
473	603686	福龙马	6,700	86,564.00	0.04
474	600595	中孚实业	15,400	86,548.00	0.04
475	605188	国光连锁	7,400	86,506.00	0.04
476	300892	品渥食品	4,600	86,388.00	0.04
477	002017	东信和平	5,900	86,317.00	0.04
478	300220	金运激光	8,300	86,237.00	0.04
479	600486	扬农化工	1,700	86,190.00	0.04
480	300380	安硕信息	2,800	86,156.00	0.04
481	300987	川网传媒	7,000	86,100.00	0.04
482	002988	豪美新材	3,900	86,034.00	0.04
483	600531	豫光金铅	5,800	85,608.00	0.04
484	300837	浙矿股份	3,600	85,536.00	0.04
485	000758	中色股份	13,000	85,410.00	0.04
486	002243	力合科创	13,000	85,410.00	0.04
487	300348	长亮科技	9,700	85,360.00	0.04
488	600803	新奥股份	5,400	85,320.00	0.04
489	301091	深城交	5,500	85,250.00	0.04
490	002882	金龙羽	4,500	85,005.00	0.04
491	300502	新易盛	140	84,980.00	0.04
492	002941	新疆交建	9,000	84,960.00	0.04
493	301551	无线传媒	4,300	84,839.00	0.04
494	002827	高争民爆	3,500	84,490.00	0.04
495	603988	中电电机	5,200	84,344.00	0.04
496	601212	白银有色	16,600	84,328.00	0.04
497	603993	洛阳钼业	4,800	84,240.00	0.04
498	600298	安琪酵母	2,322	84,056.40	0.04
499	601298	青岛港	10,400	83,720.00	0.04
500	601069	西部黄金	3,800	83,600.00	0.04
501	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.04
502	002299	圣农发展	5,500	83,380.00	0.04
503	688248	南网科技	1,200	83,016.00	0.04
504	000917	电广传媒	12,400	82,956.00	0.04
505	301518	长华化学	3,100	81,220.00	0.04
506	603486	科沃斯	1,600	81,200.00	0.04
507	603052	可川科技	1,000	80,990.00	0.04
508	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.04
509	688484	南芯科技	1,400	79,086.00	0.04

510	002378	章源钨业	2,300	77,004.00	0.04
511	002670	国盛证券	7,000	77,000.00	0.04
512	688065	凯赛生物	1,600	76,560.00	0.04
513	600008	首创环保	28,100	76,432.00	0.04
514	601126	四方股份	1,200	75,840.00	0.04
515	603893	瑞芯微	400	75,344.00	0.04
516	300458	全志科技	1,900	74,974.00	0.04
517	603259	药明康德	600	74,706.00	0.04
518	688336	三生国健	1,395	74,074.50	0.04
519	000988	华工科技	400	73,844.00	0.04
520	688100	威胜信息	2,400	73,416.00	0.04
521	600893	航发动力	1,900	72,846.00	0.04
522	002600	领益智造	4,200	72,828.00	0.04
523	688617	惠泰医疗	400	72,624.00	0.04
524	600879	航天电子	3,400	72,386.00	0.04
525	300759	康龙化成	2,500	72,325.00	0.04
526	000636	风华高科	1,000	72,240.00	0.04
527	603171	税友股份	1,800	71,730.00	0.04
528	600547	山东黄金	3,100	71,579.00	0.04
529	000729	燕京啤酒	7,000	70,910.00	0.04
530	601208	东材科技	1,000	70,790.00	0.04
531	002648	卫星化学	3,000	70,470.00	0.04
532	688593	新相微	1,800	70,056.00	0.04
533	603885	吉祥航空	6,800	69,972.00	0.04
534	002270	华明装备	3,700	69,745.00	0.03
535	600060	海信视像	2,500	69,675.00	0.03
536	601225	陕西煤业	3,400	69,190.00	0.03
537	688262	国芯科技	1,600	69,168.00	0.03
538	600699	均胜电子	3,200	69,152.00	0.03
539	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.03
540	688800	瑞可达	720	69,098.40	0.03
541	000921	海信家电	2,500	68,300.00	0.03
542	002130	沃尔核材	3,600	68,256.00	0.03
543	000423	东阿阿胶	1,500	68,040.00	0.03
544	000811	冰轮环境	1,200	67,464.00	0.03
545	002838	道恩股份	2,200	67,364.00	0.03
546	601001	晋控煤业	3,800	66,082.00	0.03
547	002859	洁美科技	600	65,706.00	0.03
548	601108	财通证券	7,500	64,875.00	0.03
549	002871	伟隆股份	2,900	64,699.00	0.03
550	688381	帝奥微	1,200	64,200.00	0.03
551	600765	中航重机	4,900	63,308.00	0.03
552	300763	锦浪科技	700	63,245.00	0.03

553	600489	中金黄金	3,500	63,175.00	0.03
554	601717	中创智领	4,500	62,595.00	0.03
555	300073	当升科技	1,300	62,452.00	0.03
556	000408	藏格矿业	900	62,388.00	0.03
557	688206	概伦电子	1,400	62,118.00	0.03
558	002517	恺英网络	3,800	61,750.00	0.03
559	688563	航材股份	1,200	61,476.00	0.03
560	002050	三花智控	1,400	61,362.00	0.03
561	600862	中航高科	3,400	61,302.00	0.03
562	601698	中国卫通	2,000	60,500.00	0.03
563	002812	恩捷股份	900	60,219.00	0.03
564	002636	金安国纪	500	59,985.00	0.03
565	600426	华鲁恒升	2,500	59,800.00	0.03
566	688818	电科蓝天	850	59,619.00	0.03
567	600578	京能电力	9,200	59,340.00	0.03
568	300672	国科微	200	59,000.00	0.03
569	688029	南微医学	800	57,440.00	0.03
570	300498	温氏股份	4,600	56,672.00	0.03
571	601872	招商轮船	3,200	56,224.00	0.03
572	600196	复星医药	2,500	56,175.00	0.03
573	300390	天华新能	600	56,106.00	0.03
574	300806	斯迪克	500	56,000.00	0.03
575	603565	中谷物流	5,700	55,917.00	0.03
576	688508	芯朋微	600	55,776.00	0.03
577	600739	辽宁成大	5,400	54,594.00	0.03
578	600737	中粮糖业	4,400	54,252.00	0.03
579	301161	唯万密封	1,400	54,054.00	0.03
580	001203	大中矿业	1,800	53,910.00	0.03
581	000959	首钢股份	15,000	52,650.00	0.03
582	301235	华康洁净	700	52,507.00	0.03
583	600268	国电南自	4,500	52,290.00	0.03
584	688625	呈和科技	600	50,646.00	0.03
585	600026	中远海能	2,800	50,232.00	0.03
586	002993	奥海科技	700	50,127.00	0.03
587	688820	盛合晶微	352	49,804.48	0.02
588	688515	裕太微	200	49,752.00	0.02
589	002922	伊戈尔	1,500	49,200.00	0.02
590	002311	海大集团	1,100	49,071.00	0.02
591	688166	博瑞医药	1,400	49,014.00	0.02
592	688300	联瑞新材	200	48,880.00	0.02
593	603281	江瀚新材	1,200	48,756.00	0.02
594	000887	中鼎股份	2,700	48,303.00	0.02
595	600038	中直股份	1,900	48,051.00	0.02

596	688239	航宇科技	800	47,864.00	0.02
597	688612	威迈斯	1,600	47,344.00	0.02
598	600166	福田汽车	16,200	47,142.00	0.02
599	603025	大豪科技	3,400	46,376.00	0.02
600	688691	灿芯股份	400	46,372.00	0.02
601	300003	乐普医疗	3,900	46,215.00	0.02
602	600483	福能股份	4,500	45,855.00	0.02
603	688107	安路科技	1,000	45,600.00	0.02
604	688449	联芸科技	522	45,053.82	0.02
605	300969	恒帅股份	480	45,004.80	0.02
606	688279	峰昭科技	200	44,888.00	0.02
607	300638	广和通	2,400	44,424.00	0.02
608	600585	海螺水泥	2,600	44,070.00	0.02
609	600367	红星发展	700	44,051.00	0.02
610	688798	艾为电子	600	43,992.00	0.02
611	600323	瀚蓝环境	1,600	43,936.00	0.02
612	301029	怡合达	1,600	43,216.00	0.02
613	688012	中微公司	92	43,102.00	0.02
614	002448	中原内配	3,500	43,050.00	0.02
615	300661	圣邦股份	300	43,044.00	0.02
616	688191	智洋创新	1,200	42,840.00	0.02
617	603989	艾华集团	800	42,000.00	0.02
618	688712	北芯生命	1,167	41,918.64	0.02
619	603296	华勤技术	560	41,591.20	0.02
620	601858	中国科传	2,400	41,544.00	0.02
621	000009	中国宝安	6,600	41,118.00	0.02
622	601117	中国化学	5,500	40,425.00	0.02
623	002085	万丰奥威	3,600	39,924.00	0.02
624	600028	中国石化	8,900	39,694.00	0.02
625	603456	九洲药业	2,900	39,614.00	0.02
626	600348	华阳股份	5,100	39,015.00	0.02
627	688797	臻宝科技	83	38,899.61	0.02
628	603799	华友钴业	800	38,608.00	0.02
629	000975	山金国际	2,200	37,400.00	0.02
630	605277	新亚电子	1,920	36,595.20	0.02
631	603040	新坐标	580	36,580.60	0.02
632	002079	苏州固锝	2,400	36,072.00	0.02
633	301200	大族数控	100	36,065.00	0.02
634	600877	电科芯片	2,100	35,973.00	0.02
635	603605	珀莱雅	600	35,952.00	0.02
636	603444	吉比特	100	35,842.00	0.02
637	301045	天禄科技	400	35,632.00	0.02
638	605133	嵘泰股份	900	35,433.00	0.02

639	600863	华能蒙电	7,500	35,250.00	0.02
640	603556	海兴电力	1,600	35,200.00	0.02
641	600131	国网信通	2,400	35,040.00	0.02
642	600282	南钢股份	7,600	34,884.00	0.02
643	688785	恒运昌	75	34,736.25	0.02
644	688591	泰凌微	1,000	34,380.00	0.02
645	688686	奥普特	200	33,678.00	0.02
646	600177	雅戈尔	4,400	33,132.00	0.02
647	600233	圆通速递	2,100	33,075.00	0.02
648	688685	迈信林	600	32,940.00	0.02
649	688635	长进光子	104	32,051.76	0.02
650	688063	派能科技	600	31,962.00	0.02
651	300058	蓝色光标	2,300	31,648.00	0.02
652	688332	中科蓝讯	200	31,500.00	0.02
653	688653	康希通信	1,800	31,284.00	0.02
654	300748	金力永磁	1,000	30,850.00	0.02
655	001399	惠科股份	1,110	30,780.30	0.02
656	000883	湖北能源	6,900	29,808.00	0.01
657	605111	新洁能	300	29,742.00	0.01
658	000061	农产品	5,300	29,680.00	0.01
659	301110	青木科技	780	29,530.80	0.01
660	600143	金发科技	1,900	29,355.00	0.01
661	600325	华发股份	12,700	29,337.00	0.01
662	600398	海澜之家	5,600	29,288.00	0.01
663	688209	英集芯	1,000	29,080.00	0.01
664	605287	德才股份	700	29,043.00	0.01
665	301286	侨源股份	500	28,995.00	0.01
666	688512	慧智微	1,800	28,746.00	0.01
667	000429	粤高速 A	2,100	28,665.00	0.01
668	000733	振华科技	500	28,320.00	0.01
669	002222	福晶科技	300	27,684.00	0.01
670	600577	精达股份	2,800	27,384.00	0.01
671	601799	星宇股份	300	27,186.00	0.01
672	603733	仙鹤股份	1,000	27,010.00	0.01
673	001267	汇绿生态	500	26,750.00	0.01
674	000543	皖能电力	3,500	26,495.00	0.01
675	002065	东华软件	3,700	26,418.00	0.01
676	600499	科达制造	1,900	26,220.00	0.01
677	002706	良信股份	2,400	26,184.00	0.01
678	300034	钢研高纳	1,500	25,710.00	0.01
679	688222	成都先导	800	25,688.00	0.01
680	603826	坤彩科技	1,000	25,560.00	0.01
681	300304	云意电气	1,400	24,990.00	0.01

682	002832	比音勒芬	1,200	24,768.00	0.01
683	688601	力芯微	400	24,220.00	0.01
684	688252	天德钰	1,000	24,000.00	0.01
685	300320	海达股份	2,500	23,850.00	0.01
686	688173	希荻微	1,200	22,968.00	0.01
687	300881	盛德鑫泰	600	22,470.00	0.01
688	300727	润禾材料	600	22,452.00	0.01
689	300772	运达股份	1,800	22,140.00	0.01
690	603019	中科曙光	200	21,446.00	0.01
691	001257	盛龙股份	1,025	21,258.50	0.01
692	000737	北方铜业	1,600	21,152.00	0.01
693	002782	可立克	1,000	21,050.00	0.01
694	301361	众智科技	700	21,021.00	0.01
695	002603	以岭药业	1,400	21,000.00	0.01
696	600970	中材国际	2,800	19,964.00	0.01
697	002488	金固股份	2,200	19,602.00	0.01
698	688620	安凯微	1,200	19,440.00	0.01
699	002458	益生股份	2,500	19,425.00	0.01
700	688811	有研新材	794	19,392.80	0.01
701	301510	固高科技	600	19,158.00	0.01
702	600873	梅花生物	2,600	19,110.00	0.01
703	600645	中源协和	1,100	18,821.00	0.01
704	001308	康冠科技	900	18,774.00	0.01
705	000776	广发证券	800	18,720.00	0.01
706	688557	兰剑智能	600	18,618.00	0.01
707	688595	芯海科技	400	17,544.00	0.01
708	688182	灿勤科技	400	17,228.00	0.01
709	601222	林洋能源	3,200	17,024.00	0.01
710	003035	南网能源	2,800	16,296.00	0.01
711	601339	百隆东方	2,400	16,248.00	0.01
712	000035	中国天楹	3,300	15,939.00	0.01
713	002283	天润工业	1,600	15,440.00	0.01
714	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
715	300383	光环新网	1,200	14,928.00	0.01
716	603459	红板科技	170	14,696.97	0.01
717	301531	春光集团	283	14,591.48	0.01
718	000513	丽珠集团	500	14,445.00	0.01
719	601216	君正集团	3,000	13,380.00	0.01
720	600566	济川药业	600	13,314.00	0.01
721	002284	亚太股份	1,400	13,286.00	0.01
722	301696	三瑞智能	151	13,106.80	0.01
723	301669	高特电子	460	13,064.00	0.01
724	000400	许继电气	600	13,020.00	0.01

725	600511	国药股份	500	13,020.00	0.01
726	603407	长裕集团	163	12,820.54	0.01
727	000301	东方盛虹	1,100	12,595.00	0.01
728	605389	长龄液压	120	11,520.00	0.01
729	600219	南山铝业	2,800	11,172.00	0.01
730	301599	理奇智能	301	9,773.47	0.00
731	301680	固德电材	84	9,421.44	0.00
732	600353	旭光电子	200	9,120.00	0.00
733	688796	百奥赛图	79	8,642.60	0.00
734	605305	中际联合	200	8,384.00	0.00
735	001365	天海电子	255	7,984.05	0.00
736	603013	亚普股份	500	7,895.00	0.00
737	001393	维通利	192	7,691.46	0.00
738	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
739	301683	慧谷新材	56	6,819.12	0.00
740	001369	双欣材料	493	6,665.36	0.00
741	688816	易思维	116	6,623.60	0.00
742	688090	瑞松科技	60	6,387.00	0.00
743	001237	惠康科技	101	5,932.74	0.00
744	688215	瑞晟智能	133	5,341.28	0.00
745	601112	振石股份	278	4,890.02	0.00
746	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
747	688805	健信超导	65	3,053.05	0.00
748	603352	至信股份	102	2,603.04	0.00
749	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
750	301608	博实结	41	2,060.66	0.00
751	688330	宏力达	51	1,725.33	0.00
752	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
753	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
754	001312	福恩股份	89	1,493.42	0.00
755	603293	埃泰克	44	1,492.92	0.00
756	301053	远信工业	40	1,476.00	0.00
757	001285	瑞立科密	15	616.95	0.00
758	300752	隆利科技	20	269.40	0.00
759	688584	上海合晶	4	143.80	0.00
760	600694	大商股份	10	132.30	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------	----------------

1	300308	中际旭创	5,922,345.00	2.20
2	603568	伟明环保	3,869,955.00	1.44
3	688127	蓝特光学	3,574,699.87	1.33
4	300857	协创数据	3,458,534.00	1.29
5	688256	寒武纪	3,438,657.72	1.28
6	002284	亚太股份	3,351,699.00	1.25
7	002532	天山铝业	3,325,345.00	1.24
8	603588	高能环境	3,209,816.00	1.19
9	002001	新 和 成	3,170,930.00	1.18
10	300750	宁德时代	3,165,495.00	1.18
11	600487	亨通光电	3,129,958.00	1.16
12	688002	睿创微纳	3,092,000.64	1.15
13	600201	生物股份	3,011,473.00	1.12
14	002922	伊戈尔	3,003,083.11	1.12
15	002008	大族激光	2,921,646.00	1.09
16	300919	中伟新材	2,916,045.00	1.08
17	000408	藏格矿业	2,878,486.00	1.07
18	600988	赤峰黄金	2,848,878.00	1.06
19	300476	胜宏科技	2,807,296.00	1.04
20	688008	澜起科技	2,798,520.86	1.04

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	5,189,791.00	1.93
2	002001	新 和 成	4,126,568.16	1.53
3	002414	高德红外	3,973,811.00	1.48
4	300857	协创数据	3,810,490.60	1.42
5	002008	大族激光	3,703,302.00	1.38
6	600487	亨通光电	3,606,009.00	1.34
7	688127	蓝特光学	3,596,130.70	1.34
8	300476	胜宏科技	3,454,033.00	1.28
9	603588	高能环境	3,434,808.00	1.28
10	002156	通富微电	3,422,788.00	1.27
11	688012	中微公司	3,414,106.31	1.27
12	002284	亚太股份	3,352,825.00	1.25
13	002048	宁波华翔	3,350,222.00	1.25
14	603568	伟明环保	3,305,077.00	1.23
15	600166	福田汽车	3,150,427.00	1.17
16	000600	建投能源	3,010,975.00	1.12
17	300750	宁德时代	2,973,607.00	1.11

18	002518	科士达	2,944,404.00	1.10
19	002895	川恒股份	2,930,649.00	1.09
20	002532	天山铝业	2,911,547.94	1.08

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,199,171,139.40
卖出股票收入（成交）总额	1,326,015,868.43

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	42,930.83	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,930.83	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113702	斯达转债	160	42,930.83	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，南亚新材料科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾被上海证券交易所予以监管警示。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,142,768.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,553.85
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,148,321.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投量化进取 A	3,564	33,483.97	950,966.33	0.7969%	118,385,902.41	99.2031%
中信建投量化进取 C	1,026	33,484.09	0.00	0.0000%	34,354,674.07	100.0000%
合计	4,542	33,837.86	950,966.33	0.6187%	152,740,576.48	99.3813%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.9479%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持	中信建投量化进取 A	255,192.69	0.2138%

有本基金	中信建投量化进取 C	—	—
	合计	255,192.69	0.1660%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投量化进取 A	0
	中信建投量化进取 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投量化进取 A	0
	中信建投量化进取 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C
基金合同生效日（2021 年 03 月 09 日）基金份额总额	927,254,063.16	373,861,421.81
本报告期期初基金份额总额	183,953,996.43	58,325,222.77
本报告期基金总申购份额	1,768,677.22	402,903.69
减：本报告期基金总赎回份额	66,385,804.91	24,373,452.39
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	119,336,868.74	34,354,674.07

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

2026 年 6 月，经基金托管人中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金托管业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	2	2,524,135,803.14	100.00%	1,113,234.80	100.00%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	10,092,964.69	100.00%	39,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-01-22
2	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2026-02-04
4	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	规定网站、规定报刊	2026-02-13
5	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2026-02-25
6	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026-02-25
7	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资	规定网站	2026-02-25

	资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新		
8	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026-03-31
9	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-31
10	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2025 年度）	规定网站	2026-03-31
11	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-04-22
12	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
13	中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-04-25

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日